

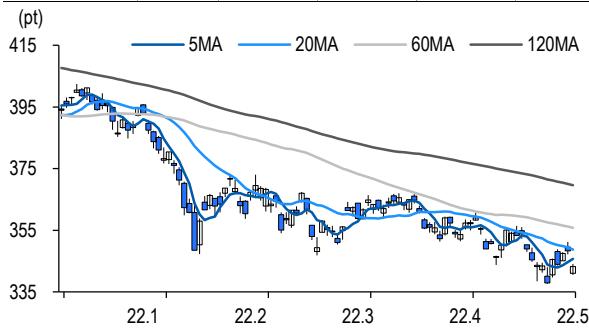


선물옵션시장 지표

2022.5.20

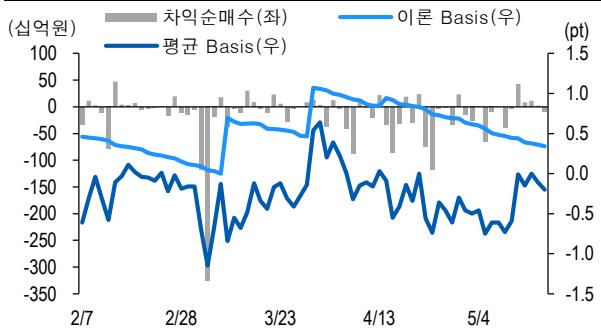
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.24	-1.46	-5.10	6,769.6	-
선물 6월물	342.10	-1.81	-6.30	25,525.5	294,862
선물 9월물	342.10	-1.79	-6.25	154.6	14,000
6월물(mini)	342.22	-1.77	-6.04	1,787.5	59,898
7월물(mini)	342.50	-1.49	-5.18	11.6	7,688



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.34	-0.20	-1.14	-0.16%
베이시스(mini)	0.34	-0.20	-1.02	-0.16%
제1스프레드(SP)	0.46	-0.04	-0.05	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.34	-0.41	-0.41	-0.22%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

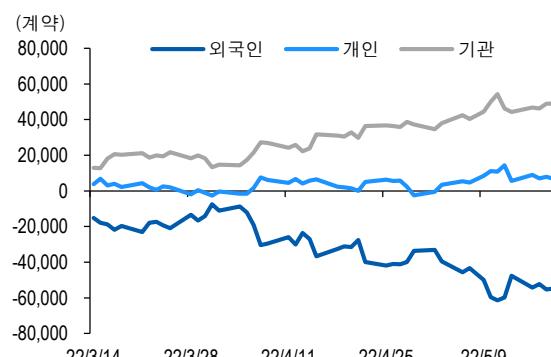
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-99.6	-18.5	-118.2	0.4	-27.4	72.8	-30.6	3.0	4.9	-4.4
개인	521.6	61.5	583.1	0.0	-1.0	-104.2	13.2	-1.4	-2.7	16.8
기관	-482.2	-45.8	-528.0	-8.7	-34.9	-22.9	17.0	-1.2	-1.6	-12.0
금융투자	-354.0	-170.2	-524.1	-0.2	-30.4	180.8	17.8	0.3	-0.5	4.5
투신	-31.4	21.4	-10.1	0.0	17.8	-247.9	-0.6	0.0	-0.2	-21.8
은행+보험+기타금융	-10.0	34.1	24.1	0.0	-11.5	8.4	-0.1	-1.5	-1.0	0.1
연기금+국가지자체	32.6	40.7	73.3	-8.5	0.1	35.8	0.0	0.0	0.0	5.3
기타법인	60.2	2.9	63.1	0.0	0.5	54.3	0.4	-0.4	-0.5	-0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	831,251	242.7	783,082	15.6%	지수옵션 전체	1,666,976	554.3	2,040,812							
Put	835,725	311.6	1,257,730	20.4%	PCR(금액기준)	1.28	VKOSPI	20.42% (+2.02%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	355.0(K+3)	1.43	-1.24	97,351	22,292	1,749	15.5	Put	350.0(K+1)	10.50	3.94	1,742	20,226	-342	20.1
	352.5(K+2)	2.04	-1.66	68,318	8,883	414	15.7		347.5(K+0)	8.40	3.00	4,955	6,329	-202	18.5
	350.0(K+1)	2.80	-1.94	63,457	16,991	1,318	15.9		345.0(K-1)	7.60	3.23	6,258	12,167	322	20.4
	347.5(K+0)	3.73	-2.34	28,218	6,449	1,121	16.2		342.5(K-2)	6.38	2.77	7,413	5,082	921	20.6
	345.0(K-1)	4.81	-2.74	13,528	13,183	2,581	16.3		340.0(K-3)	5.24	2.37	14,837	19,762	-647	20.6

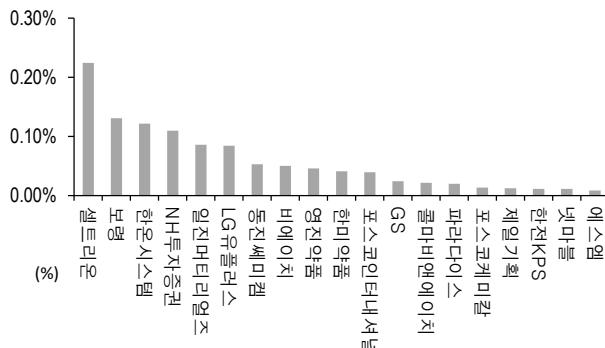
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,584,980	2,442.9	4,572,894	34,230	-45,962	22,496	22,652	-4.4	16.8	-12.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,270	-1.72	1.9	91.3	8,903	607	-0.57%	-1,835	124	1,732
SK 하이닉스	111,000	-2.20	328.2	80.5	194,600	-1,020	-0.10%	-2,147	-2,760	4,857
일진미터리얼즈	93,900	5.86	52.8	78.4	103,467	12,906	0.09%	577	12,741	-13,318
삼성전자	67,500	-0.74	828.0	74.0	1,277,673	-28,767	-0.11%	-25,490	23,507	2,296
넷마블	80,200	5.25	18.3	64.5	13,501	-7,253	0.01%	-3,078	1,470	1,603
삼성전기	158,500	-1.55	34.0	62.3	32,862	520	-0.08%	688	-2,340	1,652
현대차	181,500	-2.16	58.7	59.6	50,506	-2,321	-0.18%	2,712	-874	-1,779
엔씨소프트	431,500	-1.03	27.2	54.0	10,246	170	-0.03%	137	81	-218
KT	36,300	0.14	19.0	51.8	61,118	-3,799	-0.06%	3,333	2,154	-5,469
포스코케미칼	128,500	3.63	26.7	47.0	15,258	-919	0.01%	4,365	-1,793	-2,772

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터